

Fecha de Publicación: 9 de septiembre de 2013

Fecha de Información: 05 de septiembre de 2013 <sup>1</sup>

## INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1644,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	120,1	312,9	138,5	25,0	114,4	35,1	60,0
15-35	401,0	522,9	368,0	139,0	69,9	177,0	85,0
36-60	133,6	69,0	0,0	50,0	69,0	83,6	0,0
61-90	33,3	24,1	0,0	0,0	23,1	32,3	1,0
91-180	59,5	20,5	0,0	1,6	17,0	54,4	3,5
>180	39,3	71,6	20,0	0,6	37,6	24,7	14,0
<b>Total</b>	<b>786,8</b>	<b>1020,9</b>	<b>526,5</b>	<b>216,2</b>	<b>331,0</b>	<b>407,1</b>	<b>163,5</b>

\* Cifras en millones de dólares

\*\*Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

\*\*\*Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

**Cuadro No. 2**

### Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,4 %	3,0 %	2,7 %	3,0 %
15-35	3,5 %	3,4 %	3,0 %	3,2 %
36-60	-	3,5 %	3,0 %	3,2 %
61-90	3,2 %	3,8 %	3,0 %	3,3 %
91-180	3,2 %	3,5 %	2,7 %	2,9 %
>180	3,4 %	3,0 %	2,9 %	3,0 %
<b>Total</b>	<b>3,4 %</b>	<b>3,2 %</b>	<b>3,0 %</b>	<b>3,2 %</b>

\*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	2 al 6 de septiembre				9 al 13 de septiembre				16 al 20 de septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	3	73	3838	3659	24	66	3734	3352	51	65	2694	2731
Intragrupa y off-shore***	0	1	1684	1353	0	0	1409	918	0	0	1610	667
Otros	73	2	637	1146	66	24	604	1476	65	51	437	1344
<b>Total</b>	<b>77</b>	<b>77</b>	<b>6158</b>	<b>6158</b>	<b>90</b>	<b>90</b>	<b>5746</b>	<b>5746</b>	<b>116</b>	<b>116</b>	<b>4742</b>	<b>4742</b>

\* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

\*\*Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

\*\*\*Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.